



FICHEROS DE DATOS INDIVIDUALES DE IIC. DOCUMENTO EXPLICATIVO DE FONDPATRIMDISVAR.

DEPARTAMENTO DE ESTUDIOS, ESTADÍSTICAS Y PUBLICACIONES

27 de abril de 2017

1. ADVERTENCIA

LA INFORMACIÓN CONTENIDA EN ESTE FICHERO PROCEDE DE LAS COMUNICACIONES REALIZADAS A LA CNMV POR LAS IIC O LAS ENTIDADES QUE LA REPRESENTEN, SIENDO ELLAS LAS RESPONSABLES DE SU CALIDAD.

Las comunicaciones posteriores a la generación de este fichero no podrán ser incluidas ni habrá ediciones posteriores, salvo en casos excepcionales en que se haría pública la existencia de esa nueva edición.

Se alerta de que tanto los datos que se incluyen en este fichero como los posibles agregados que el usuario pueda hacer de los mismos, pueden presentar discrepancias respecto a datos aparentemente similares que aparezcan en las estadísticas o en informes publicados por la CNMV, ya que estos últimos además de tener en cuenta las mencionadas comunicaciones posteriores, que se hayan podido producir, pueden haber sido objeto de depuraciones en el tratamiento de los datos.

2. CONTENIDO DEL FICHERO FONDPATRIMDISVAR

La información contenida se presenta en 40 campos de los que 4 son identificativos de la IIC o del periodo de referencia. Los campos identificativos sirven para vincularse con FONDREGISTRO que contiene un amplio número de campos descriptivos y clasificatorios de la IIC.

Es un fichero de periodicidad trimestral.

Suministra información sobre la distribución del patrimonio a fin de trimestre así como sobre la variación de cada uno de los conceptos respecto al final del ejercicio anterior.

Los datos de la distribución del patrimonio (campos desde “DPIversionesFinancieras” hasta “TotalPatrimonio”) vienen expresados en unidades monetarias de la divisa del compartimento o del fondo según sea el caso.

La distribución del patrimonio viene por grandes bloques. Un detalle mayor se presenta en FONDCART.

Los datos de la variación del patrimonio (campos desde “PatrimonioFinPeriodoAnterior” hasta “PatrimonioFinPeriodoActual”) en porcentaje sobre el patrimonio medio diario del periodo, con la excepción de los dos mencionados de patrimonio de fin de periodo, anterior y actual, que vienen expresados en unidades monetarias de la divisa del compartimento o del fondo según sea el caso.

La información se facilita a nivel compartimento o fondo, según sea el caso.

El universo sobre el que se informa está formado por todos los FI.

Campos del fichero

FechaDatos: Fecha de referencia de los demás campos.

Tipo: Tipo de IIC, en este fichero sólo puede haber FI.

NumeroRegistro: Número de registro del fondo de inversión.

CodigoDivisaIIC: Divisa de denominación de la IIC.

NumeroCompartimento: Número de compartimento.

IndiceRotacionCarteraActual: Índice de rotación de la cartera (IRC). Su cálculo, a nivel de compartimento o del fondo en caso de no existir compartimentos, se efectúa mediante la fórmula siguiente:

$$IRC = [(C + V) - (S + R)] / PMD$$

Siendo

C = compras de valores habidas en el periodo

V = ventas de valores habidas en el periodo

S + R = suma de los valores absolutos del neto diario de suscripciones y reembolsos

PMD = patrimonio medio del compartimento.

Si el fichero FONDPATRIMDISVAR corresponde a un trimestre impar (marzo, septiembre) el índice estará referido al trimestre que acaba en la fecha de referencia (campo FechaDatos). Si corresponde a un trimestre par (junio, diciembre) el índice estará referido al semestre que acaba en la fecha de referencia (campo FechaDatos).

IndiceRotacionCarteraAnterior:

El mismo concepto del campo anterior pero referido a un periodo anterior. Es decir, si el FONDPATRIMDISVAR corresponde a un trimestre impar (marzo, septiembre) el índice estará referido al trimestre anterior al que acaba en la fecha de referencia (campo FechaDatos). Si corresponde a un trimestre par (junio, diciembre) el índice estará referido al semestre anterior al que acaba en la fecha de referencia (campo FechaDatos).

La tabla siguiente resume cuales serían los periodos utilizados para el calculo del índice en este campo y el anterior:

FONDPATRIMDISVAR de:	IndiceRotacionCarteraActual	IndiceRotacionCarteraAnterior
Marzo año T	Enero – Marzo año T	Octubre – Diciembre año T-1
Junio año T	Enero – Junio año T	Julio – Diciembre año T-1
Septiembre año T	Julio – Septiembre año T	Abril - Junio año T
Diciembre año T	Julio – Diciembre año T	Enero – Junio año T

DPInversionesFinancieras: Inversiones financieras (IF) a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

Es el resultado de sumar los cuatro campos siguientes

$$IF = CI + CE + IC + ID$$

CarteraInterior: Cartera interior (CI) a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

CarteraExterior: Cartera exterior (CE) a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

InteresesCartera: Intereses de la cartera de inversión (IC) a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

InversionesDudosas: Inversiones dudosas, morosas o en litigio a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

Liquidez: Liquidez (tesorería) (L) a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

Resto: Resto (R) a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

TotalPatrimonio: Total patrimonio (TP) a fin del periodo. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

$$TP = IF + L + R$$

PatrimonioFinPeriodoAnterior: Corresponde al patrimonio de fin del ejercicio anterior. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.

Suscripciones Reembolsos Netos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Neto de suscripciones y reembolsos del periodo” sobre el patrimonio medio diario del periodo.

BeneficiosBrutosDistribuidos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Beneficios brutos distribuidos” sobre el patrimonio medio del periodo (BBD).

RendimientosNetos: que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Rendimientos netos del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (RN).

$$RN = RG - GR + ING$$

RendimientosGestion: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Rendimiento de gestión del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (RG).

$$RG = INT + DIV + RRF + RRV + RDEP + RDER + RIIC + ORES + OREN$$

Intereses: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Intereses del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (INT).

Dividendos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Dividendos del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (DIV).

ResultadosRentaFija: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Resultados en renta fija (realizados o no) del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (RRF).

ResultadosRentaVariable: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Resultados en renta variable (realizados o no) del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (RRV).

ResultadosDepositos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Resultados en depósitos (realizados o no) del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (RDEP).

ResultadosDerivados: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Resultados en derivados (realizados o no) del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (REDR).

ResultadosIIC: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Resultados en IIC (realizados o no) del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (RIIC).

OtrosResultados: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Otros resultados del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (ORES).

OtrosRendimientos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de “Otros rendimientos del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (OREN).

GastosRepercutidos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Gastos repercutidos del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (GR).

$GR = CGES + CDEP + GSE + OGGC + OGR$

ComisionGestion: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Comisión de sociedad gestora del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (CGES).

ComisionDepositario: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Comisión de depositario del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (CDEP).

GastosServiciosExteriores: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Gastos por servicios exteriores del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (GSE).

OtrosGastosGestion: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Otros gastos de gestión corriente del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (OGR).

OtrosGastosRepercutidos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Otros gastos repercutidos del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (OGR).

Ingresos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Ingresos del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (ING).

$ING = CDFAV + CRETRO + OING$

ComisionesDescuento: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Comisiones de descuento a favor de la IIC del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (CDFAV). .

ComisionesRetrocedidas: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Comisiones retrocedidas del periodo” sobre el patrimonio medio del periodo (CRETRO).

OtrosIngresos: % que representa la variación acumulada desde el final del año anterior de la partida “Otros ingresos del periodo (OING)” sobre el patrimonio medio del periodo.

PatrimonioFinPeriodoActual: Patrimonio de fin del periodo actual. En unidades de la divisa de la denominación de la IIC.